

Halbjahresbericht 2017

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2017

FORTUNA Multi INDEX 10
FORTUNA Multi INDEX 20
FORTUNA Multi INDEX 30
FORTUNA Multi INDEX 40



Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2017

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
FORTUNA Multi INDEX 10	3	CH0110739056
FORTUNA Multi INDEX 20	8	CH0109560166
FORTUNA Multi INDEX 30	13	CH0109560406
FORTUNA Multi INDEX 40	18	CH0109560422
Vertriebs- und Zahlstellen	23	

Verkaufsrestriktionen

Anteile der Teilvermögen dürfen innerhalb der USA weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Anlegern, die US Persons sind, dürfen keine Anteile dieses Anlagefonds angeboten, verkauft oder ausgeliefert werden. Eine US Person ist eine Person, die:

- (i) eine United States Person im Sinne von Paragraph 7701(a)(30) des US Internal Revenue Code von 1986 in der geltenden Fassung sowie der in dessen Rahmen erlassenen Treasury Regulations ist;
- (ii) eine US Person im Sinne von Regulation S des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (17 CFR § 230.902(k)) ist;
- (iii) keine Non-United States Person im Sinne von Rule 4.7 der US Commodity Futures Trading Commission Regulations (17 CFR § 4.7(a)(1)(iv)) ist;
- (iv) sich im Sinne von Rule 202(a)(30)-1 des US Investment Advisers Act von 1940 in der geltenden Fassung in den Vereinigten Staaten aufhält; oder
- (v) ein Trust, eine Rechtseinheit oder andere Struktur ist, die zu dem Zweck gegründet wurde, dass US Persons in diesen Anlagefonds investieren können.

Internetadresse

www.fortunainvest.ch

Organisation

Fondsleitung

Fortuna Investment AG, Adliswil

Verwaltungsrat

René Schmidli, Präsident

Eleonora Sokolarski, Mitglied

Martha Dagmar Böckenfeld, Mitglied

Ulrich Ostholt, Mitglied

Geschäftsleitung

David Küttel,
Geschäftsführer

Claudio Burkhard, Stv. Geschäftsführer

Marc Engel, Mitglied

Depotbank

EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung
Lugano

Zahlstellen

EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung
Lugano, Via Magatti 2, 6900 Lugano

Hinterlegungsstelle

EFG Bank AG, Zürich, Zweigniederlassung Lugano

Kundenbetreuung

investment.ch@generali.com
Tel. +41-58-472-53-06

Delegation weiterer Teilaufgaben

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenplatz 6, 4002 Basel delegiert: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an. Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Fortuna Investment AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Zürich

Publizität

Die Fondsleitung veröffentlicht einen Jahresbericht sowie einen ungeprüften Halbjahresbericht, welche bei der Fondsleitung, der Depotbank, den Zahlstellen, bei allen Zeichnungsstellen der Teilvermögen sowie im Internet unter **www.fortunainvest.ch** und auf **www.swissfunddata.ch** bezogen werden können. Die Nettoinventarwerte der Anteile (mit Vermerk bezüglich Kommissionen) werden täglich in der «Neuen Zürcher Zeitung» sowie im «Le Temps» publiziert.

FORTUNA Multi INDEX 10

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		6 161 320.80	6 148 741.85	6 025 431.58
	CH0110739056			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		109.20	109.52	111.82
Anzahl Anteile im Umlauf		56 421,0000	56 145,0000	53 885,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Swiss Confederation	19,22
iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 CH	18,32
Swiss Index Platform – SIP Swiss Government Bond Index	18,16
Syz AM CH Track – Swiss Government Bonds	16,60
iShares Barclays 7-10 Year Treasury Bond Fund	6,84
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y Investment ETF-C-CAP	6,02
iShares SMI CH	4,95
iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)	2,93
SPDR S&P 500 ETF Trust	2,03
iShares II PLC - iShares UK GILTS UCITS ETF GBP	2,00
Total	97,07

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	185 369.11	295 667.45
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 187 000.00	0.00
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	4 808 865.06	5 841 195.88
Derivative Finanzinstrumente	-17 148.43	0.00
Sonstige Vermögenswerte	12 892.62	27 209.02
Gesamtfondsvermögen	6 176 978.36	6 164 072.35
Andere Verbindlichkeiten	-15 657.56	-15 330.50
Nettofondsvermögen	6 161 320.80	6 148 741.85

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	581.60	679.97
Negativzinsen	-484.96	-2 221.93
Erträge der Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 073.60	0.00
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	21 979.05	81 899.17
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	3 041.62	4 372.00
Erträge der Effektenleihe	379.04	554.20
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	-36.41	192.26
Total Ertrag	26 533.54	85 475.67
Aufwand		
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-30 841.72	-61 450.33
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	63 436.67
Sonstige Aufwendungen	-30.33	-60.31
Total Aufwand	-30 872.05	1 926.03
Nettoertrag	-4 338.51	87 401.70
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	97 785.83	6 236.64
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	-63 436.67
Realisierter Erfolg	93 447.32	30 201.67
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-80 696.29	-117 798.80
Gesamterfolg	12 751.03	-87 597.13

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	6 148 741.85	6 025 431.58
Abgeführte Verrechnungssteuer	-30 590.59	-39 961.09
Saldo aus dem Anteilverkehr	30 418.51	250 868.49
Gesamterfolg	12 751.03	-87 597.13
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	6 161 320.80	6 148 741.85

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	56 145,0000	53 885,0000
Ausgegebene Anteile	276,0000	2 260,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	56 421,0000	56 145,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	276,0000	2 260,0000

¹ gemäss Mitteilung der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 1. Januar 2009

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	----------------------------------	--------------------	-----------------------	----------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Eurozone							
ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)*	EUR	5 020	1 400	2 000	4 420	181 132	2,93
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y INVEST ETF-C-CAP*	EUR	4 700		2 800	1 900	371 935	6,02
Total Eurozone						553 067	8,95
Schweiz							
ISHARE ISHARES ETF SMI*	CHF	3 370	300	450	3 220	305 610	4,95
ISHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 7-15 CH*	CHF	12 556		3 000	9 556	1 131 526	18,32
Total Schweiz						1 437 136	23,27
Grossbritannien							
ISHARES II PLC - ISHARES UK GILTS UCITS ETF GBP*	GBP		7 300		7 300	123 339	2,00
Total Grossbritannien						123 339	2,00
Vereinigte Staaten							
ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR TREASURY BOND FUND*	USD		4 100		4 100	422 542	6,84
SPDR S&P 500 ETF TRUST-S1*	USD	665		150	515	125 191	2,03
Total Vereinigte Staaten						547 734	8,87
Total Investmentzertifikate, open end						2 661 276	43,08

Anleihen, fester Zins

CHF							
SWITZERLAND 1.25000% 14-28.05.26*	CHF		300 000		300 000	335 550	5,43
SWITZERLAND 3.25000% 07-27.06.27*	CHF		300 000		300 000	395 850	6,41
SWITZERLAND 4.00000% 98-08.04.28*	CHF		100 000		100 000	141 800	2,30
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF		300 000		300 000	313 800	5,08
Total CHF						1 187 000	19,22
Total Anleihen, fester Zins						1 187 000	19,22
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						3 848 276	62,30

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Schweiz							
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E**	CHF	13 360	1 000	4 000	10 360	1 121 988	18,16
SYZ AM (CH) TRACK - SWISS GOVERNMENT BONDS-I1**	CHF	12 661		3 000	9 661	1 025 601	16,60
Total Schweiz						2 147 589	34,77
Total Investmentzertifikate, open end						2 147 589	34,77
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						2 147 589	34,77
Total Wertschriften						5 995 865	97,07
(davon ausgeliehen)						35 858	0,58)
Bankguthaben auf Sicht						185 369	3,00
Derivative Finanzinstrumente						-17 148	-0,28
Sonstige Vermögenswerte						12 892	0,21
Gesamtfondsvermögen						6 176 978	100,00
Andere Verbindlichkeiten						-15 657	
Nettofondsvermögen						6 161 321	

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamt- fondsvermögens ³	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	3 848 276	62,30	3 005 893	48,76
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	2 130 440	34,49	2 835 303	46,00
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	—	—	—	—
Total	5 978 716	96,79	5 841 196	94,76

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	300 000	CHF	341 010	30.11.2017	-1 889	-0.03
USD	380 000	CHF	357 580	30.11.2017	-8 560	-0.14
GBP	95 000	CHF	116 346	30.11.2017	-6 699	-0.11
					-17 148	-0.28

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	300 000	CHF	341 010	30.11.2017
USD	380 000	CHF	357 580	30.11.2017
GBP	95 000	CHF	116 346	30.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
 - Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
- berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 2% p.a. betragen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:

Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:

Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der SFAMA in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

Zusammengesetzte TER

für die letzten 12 Monate:

1,16%*

Auflegungsdatum

1.10.2010

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 1.143897

USD 1 = CHF 0.967600

GBP 1 = CHF 1.298181

* Der Zielfonds SWISS INDEX PLATFORM – SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E veröffentlicht keine TER gemäss Branchenstandard. Der Anteil der zusammengesetzten TER wird gemäss «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio von kollektiven Kapitalanlagen» ermittelt.

FORTUNA Multi INDEX 20

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		48 584 531.82	47 489 546.89	43 988 026.61
	CH0109560166			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		114.31	113.24	113.42
Anzahl Anteile im Umlauf		425 019,0000	419 359,0000	387 836,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Swiss Confederation	20,13
iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 CH	18,15
Swiss Index Platform – SIP Swiss Government Bond Index	14,99
iShares SMI CH	10,16
Syz AM CH Track – Swiss Government Bonds	9,57
iShares Barclays 7-10 Year Treasury Bond Fund	6,69
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y Investment ETF-C-CAP	5,82
SPDR S&P 500 ETF Trust	5,06
iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)	4,04
iShares II PLC - iShares UK GILTS UCITS ETF GBP	1,98
Total	96,59

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	1 555 428.71	2 211 897.94
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	9 804 000.00	0.00
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	37 240 638.11	45 234 594.44
Derivative Finanzinstrumente	-136 278.11	0.00
Sonstige Vermögenswerte	243 174.51	160 211.35
Gesamtfondsvermögen	48 706 963.22	47 606 703.73
Andere Verbindlichkeiten	-122 431.40	-117 156.84
Nettofondsvermögen	48 584 531.82	47 489 546.89

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	5 076.40	6 684.79
Negativzinsen	-2 587.43	-18 526.40
Erträge der Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	7 375.00	0.00
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	217 502.66	630 327.12
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	53 854.92	60 912.22
Erträge der Effektenleihe	4 183.01	8 181.68
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	-352.80	1 802.96
Total Ertrag	285 051.76	689 382.37
Aufwand		
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-241 296.99	-459 292.18
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	480 083.35
Sonstige Aufwendungen	-30.33	-60.31
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-299.66	0.00
Total Aufwand	-241 626.98	20 730.86
Nettoertrag	43 424.78	710 113.23
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	1 221 217.21	209 957.05
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	-480 083.35
Realisierter Erfolg	1 264 641.99	439 986.93
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-561 184.53	-214 880.61
Gesamterfolg	703 457.46	225 106.32

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	47 489 546.89	43 988 026.61
Abgeführte Verrechnungssteuer	-249 581.54	-296 818.33
Saldo aus dem Anteilverkehr	641 109.01	3 573 232.29
Gesamterfolg	703 457.46	225 106.32
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	48 584 531.82	47 489 546.89

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	419 359,0000	387 836,0000
Ausgegebene Anteile	8 095,0000	31 523,0000
Zurückgenommene Anteile	-2 435,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	425 019,0000	419 359,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	5 660,0000	31 523,0000

¹ gemäss Mitteilung der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 1. Januar 2009

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	----------------------------------	--------------------	-----------------------	----------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Eurozone							
ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)*	EUR	60 569	500	13 000	48 069	1 969 872	4,04
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y INVEST ETF-C-CAP*	EUR	45 681	2 000	33 200	14 481	2 834 729	5,82
Total Eurozone						4 804 601	9,86
Schweiz							
ISHARE ISHARES ETF SMI*	CHF	57 161		5 000	52 161	4 950 601	10,16
ISHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 7-15 CH*	CHF	92 639	2 000	20 000	74 639	8 838 004	18,15
Total Schweiz						13 788 605	28,31
Grossbritannien							
ISHARES II PLC - ISHARES UK GILTS UCITS ETF GBP*	GBP		57 000		57 000	963 062	1,98
Total Grossbritannien						963 062	1,98
Vereinigte Staaten							
ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR TREASURY BOND FUND*	USD		31 600		31 600	3 256 667	6,69
SPDR S&P 500 ETF TRUST-S1*	USD	9 139	1 000		10 139	2 464 691	5,06
Total Vereinigte Staaten						5 721 358	11,75
Total Investmentzertifikate, open end						25 277 625	51,90

Anleihen, fester Zins

CHF							
SWITZERLAND 1.25000% 14-28.05.26*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 237 000	4,59
SWITZERLAND 3.25000% 07-27.06.27*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 639 000	5,42
SWITZERLAND 4.00000% 98-08.04.28*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 836 000	5,82
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 092 000	4,30
Total CHF						9 804 000	20,13
Total Anleihen, fester Zins						9 804 000	20,13

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden **35 081 625** **72,03**

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Schweiz							
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-B2**	CHF	46 448	16 000	62 448			
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E**	CHF	58 416	9 000		67 416	7 301 153	14,99
SYZ AM (CH) TRACK - SWISS GOVERNMENT BONDS-I1**	CHF	43 914			43 914	4 661 860	9,57
Total Schweiz						11 963 013	24,56

Total Investmentzertifikate, open end **11 963 013** **24,56**

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden **11 963 013** **24,56**

Total Wertschriften **47 044 638** **96,59**

(davon ausgeliehen) 3 442 0,01)

Bankguthaben auf Sicht					1 555 429	3,19
Derivative Finanzinstrumente					-136 278	-0,28
Sonstige Vermögenswerte					243 174	0,50

Gesamtfondsvermögen **48 706 963** **100,00**

Andere Verbindlichkeiten -122 431

Nettofondsvermögen **48 584 532**

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamt- fondsvermögens ³	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	35 081 625	72,03	28 954 822	60,82
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	11 826 735	24,28	16 279 772	34,19
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	—	—	—	—
Total	46 908 360	96,31	45 234 594	95,01

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	2 500 000	CHF	2 845 500	30.11.2017	-11 992	-0.02
USD	3 300 000	CHF	3 109 590	30.11.2017	-70 043	-0.14
GBP	750 000	CHF	917 175	30.11.2017	-54 243	-0.12
					-136 278	-0.28

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	2 500 000	CHF	2 845 500	30.11.2017
USD	3 300 000	CHF	3 109 590	30.11.2017
GBP	750 000	CHF	917 175	30.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
- Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.; berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 2% p.a. betragen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:

Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:

Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der SFAMA in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

Zusammengesetzte TER

für die letzten 12 Monate:

1,15%*

Auflegungsdatum

1.4.2010

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 1.143897

USD 1 = CHF 0.967600

GBP 1 = CHF 1.298181

* Der Zielfonds SWISS INDEX PLATFORM – SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E veröffentlicht keine TER gemäss Branchenstandard. Der Anteil der zusammengesetzten TER wird gemäss «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio von kollektiven Kapitalanlagen» ermittelt.

FORTUNA Multi INDEX 30

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		23 698 041.86	21 470 047.23	17 314 666.35
	CH0109560406			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		119.50	117.98	116.18
Anzahl Anteile im Umlauf		198 316,0000	181 976,0000	149 030,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Swiss Confederation	18,05
Swiss Index Platform – SIP Swiss Government Bond Index	17,09
iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 CH	16,68
iShares SMI CH	14,22
SPDR S&P 500 ETF Trust	7,20
iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)	7,09
iShares Barclays 7-10 Year Treasury Bond Fund	6,68
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y Investment ETF-C-CAP	5,66
iShares II PLC - iShares UK GILTS UCITS ETF GBP	1,95
UBS ETF (CH) - SMI (CHF) A-DIS	0,08
Total	94,70

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	1 236 533.86	993 338.25
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	4 373 300.01	0.00
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	18 560 226.47	20 464 768.42
Derivative Finanzinstrumente	-39 071.52	0.00
Sonstige Vermögenswerte	83 686.85	64 461.13
Gesamtfondsvermögen	24 214 675.67	21 522 567.80
Aufgenommene Kredite	-457 558.68	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-59 075.13	-52 520.57
Nettofondsvermögen	23 698 041.86	21 470 047.23

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	2 403.79	2 917.99
Negativzinsen	-1 423.94	-8 957.23
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	3 874.99	0.00
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	146 135.38	277 244.05
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	29 005.37	50 643.20
Erträge der Effektenleihe	3 844.36	6 091.29
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	3 093.99	6 873.59
Total Ertrag	186 933.94	334 812.89
Aufwand		
Passivzinsen	-175.19	0.00
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-113 764.87	-195 038.90
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	570 399.55
Sonstige Aufwendungen	-30.33	-60.31
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-583.19	0.00
Total Aufwand	-114 553.58	375 300.34
Nettoertrag	72 380.36	710 113.23
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	453 516.01	52 114.69
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	-570 399.55
Realisierter Erfolg	525 896.37	191 828.37
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	15 897.01	253 425.93
Gesamterfolg	541 793.38	445 254.30

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	21 470 047.23	17 314 666.35
Abgeführte Verrechnungssteuer	-258 657.40	-124 851.33
Saldo aus dem Anteilverkehr	1 944 858.65	3 834 977.91
Gesamterfolg	541 793.38	445 254.30
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	23 698 041.86	21 470 047.23

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	181 976,0000	149 030,0000
Ausgegebene Anteile	17 940,0000	32 946,0000
Zurückgenommene Anteile	-1 600,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	198 316,0000	181 976,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	16 340,0000	32 946,0000

¹ gemäss Mitteilung der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 1. Januar 2009

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	----------------------------------	--------------------	-----------------------	----------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Eurozone							
ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)*	EUR	56 369	500	15 000	41 869	1 715 796	7,09
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y INVEST ETF-C-CAP*	EUR	19 801	2 200	15 000	7 001	1 370 481	5,66
Total Eurozone						3 086 277	12,75
Schweiz							
ISHARE ISHARES ETF SMI*	CHF	38 287	800	2 800	36 287	3 443 999	14,22
ISHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 7-15 CH*	CHF	42 102		8 000	34 102	4 038 018	16,68
UBS ETF (CH) - SMI (CHF) A-DIS*	CHF		200		200	18 613	0,08
Total Schweiz						7 500 630	30,98
Grossbritannien							
ISHARES II PLC - ISHARES UK GILTS UCITS ETF GBP*	GBP		28 000		28 000	473 083	1,95
Total Grossbritannien						473 083	1,95
Vereinigte Staaten							
ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR TREASURY BOND FUND*	USD		15 700		15 700	1 618 027	6,68
SPDR S&P 500 ETF TRUST-S1*	USD	3 971	3 200		7 171	1 743 199	7,20
Total Vereinigte Staaten						3 361 227	13,88
Total Investmentzertifikate, open end						14 421 217	59,56

Anleihen, fester Zins

CHF							
SWITZERLAND 1.25000% 14-28.05.26*	CHF		950 000		950 000	1 062 575	4,39
SWITZERLAND 3.25000% 07-27.06.27*	CHF		950 000		950 000	1 253 525	5,18
SWITZERLAND 4.00000% 98-08.04.28*	CHF		750 000		750 000	1 063 500	4,39
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF		950 000		950 000	993 700	4,10
Total CHF						4 373 300	18,06
Total Anleihen, fester Zins						4 373 300	18,06
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						18 794 517	77,62

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Schweiz							
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-B2**	CHF	8 000	2 000	10 000			
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E**	CHF	40 418	16 800	19 000	38 218	4 139 009	17,08
Total Schweiz						4 139 009	17,08
Total Investmentzertifikate, open end						4 139 009	17,08
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						4 139 009	17,08
Total Wertschriften						22 933 526	94,70
(davon ausgeliehen)						672 394	2,78)
Bankguthaben auf Sicht						1 236 534	5,11
Derivative Finanzinstrumente						-39 072	-0,16
Sonstige Vermögenswerte						83 688	0,35
Gesamtfondsvermögen						24 214 676	100,00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-457 559	
Andere Verbindlichkeiten						-59 075	
Nettofondsvermögen						23 698 042	

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamt- fondsvermögens ³	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	18 794 517	77,62	15 138 965	70,34
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	4 099 937	16,92	5 325 803	24,74
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	—	—	—	—
Total	22 894 454	94,54	20 464 768	95,08

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	1 150 000	CHF	1 312 438	30.11.2017	-2 009	-0.01
USD	1 580 000	CHF	1 504 950	30.11.2017	-17 420	-0.07
GBP	330 000	CHF	407 781	30.11.2017	-19 643	-0.08
					-39 072	-0.16

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	1 150 000	CHF	1 312 438	30.11.2017
USD	1 580 000	CHF	1 504 950	30.11.2017
GBP	330 000	CHF	407 781	30.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 2% p.a. betragen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der SFAMA in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

Zusammengesetzte TER
für die letzten 12 Monate: 1,14%*

Auflegungsdatum

1.10.2010

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 1.143897 USD 1 = CHF 0.967600
GBP 1 = CHF 1.298181

* Der Zielfonds SWISS INDEX PLATFORM – SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E veröffentlicht keine TER gemäss Branchenstandard. Der Anteil der zusammengesetzten TER wird gemäss «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio von kollektiven Kapitalanlagen» ermittelt.

FORTUNA Multi INDEX 40

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2017	31.3.2017	31.3.2016
Nettofondsvermögen in CHF		97 792 077.16	87 959 052.69	69 655 162.88
	CH0109560422			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		125.72	121.89	117.99
Anzahl Anteile im Umlauf		777 884,0000	721 597,0000	590 371,0000

Struktur des Wertpapierportfolios

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
iShares SMI CH	18,59
iShares Swiss Domestic Government Bond 7-15 CH	16,96
Swiss Confederation	14,29
SPDR S&P 500 ETF Trust	9,68
iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)	9,62
Swiss Index Platform – SIP Swiss Government Bond Index	7,46
iShares Barclays 7-10 Year Treasury Bond Fund	6,94
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y Investment ETF-C-CAP	5,60
Syz AM CH Track – Swiss Government Bonds	3,84
iShares II PLC - iShares UK GILTS UCITS ETF GBP	2,05
Übrige	0,95
Total	95,98

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2017	31.3.2017
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	3 781 883.77	4 676 220.15
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	14 013 400.00	0.00
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	80 078 446.34	83 281 875.43
Derivative Finanzinstrumente	-163 782.88	0.00
Sonstige Vermögenswerte	323 165.13	216 454.27
Gesamtfondsvermögen	98 033 112.36	88 174 549.85
Andere Verbindlichkeiten	-241 035.20	-215 497.16
Nettofondsvermögen	97 792 077.16	87 959 052.69

Erfolgsrechnung

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	11 239.74	7 848.13
Negativzinsen	-8 376.73	-38 323.91
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	10 707.98	0.00
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	610 903.71	1 106 792.81
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	229 239.32	204 511.77
Erträge der Effektenleihe	17 167.34	25 712.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	15 099.28	36 768.27
Total Ertrag	885 980.64	1 343 309.30
Aufwand		
Fondsvertragliche Kommissionsvergütung an die Fondsleitung	-467 260.14	-790 403.74
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	869 180.03
Sonstige Aufwendungen	-40.43	-70.36
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-1 354.59	0.00
Total Aufwand	-468 655.16	78 705.93
Nettoertrag	417 325.48	1 422 015.23
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2 176 894.43	219 067.27
Teilübertrag der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste ¹	0.00	-869 180.03
Realisierter Erfolg	2 594 219.91	771 902.47
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	786 187.38	2 442 120.16
Gesamterfolg	3 380 407.29	3 214 022.63

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	87 959 052.69	69 655 162.88
Abgeführte Verrechnungssteuer	-516 293.28	-505 308.35
Saldo aus dem Anteilverkehr	6 968 910.46	15 595 175.53
Gesamterfolg	3 380 407.29	3 214 022.63
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	97 792 077.16	87 959 052.69

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2017-30.9.2017	1.4.2016-31.3.2017
	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	721 597,0000	590 371,0000
Ausgegebene Anteile	59 087,0000	131 226,0000
Zurückgenommene Anteile	-2 800,0000	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	777 884,0000	721 597,0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	56 287,0000	131 226,0000

¹ gemäss Mitteilung der Eidgenössischen Steuerverwaltung vom 1. Januar 2009

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.03.2017 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.09.2017 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	----------------------------------	--------------------	-----------------------	----------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Eurozone							
ISHARES EURO STOXX 50 UCITS ETF (DE)*	EUR	231 122	13 000	14 000	230 122	9 430 423	9,62
LYXOR UCITS ETF EUROMTS 7-10Y INVEST ETF-C-CAP*	EUR	107 527	7 500	87 000	28 027	5 486 427	5,60
Total Eurozone						14 916 849	15,22
Schweiz							
ISHARE ISHARES ETF SMI*	CHF	202 852	7 000	17 852	192 000	18 222 720	18,59
ISHARES SWISS DOMESTIC GOVERNMENT BOND 7-15 CH*	CHF	110 441	80 000	50 000	140 441	16 629 619	16,96
UBS ETF (CH) - SMI (CHF) A-DIS*	CHF		10 000		10 000	930 665	0,95
Total Schweiz						35 783 004	36,50
Grossbritannien							
ISHARES II PLC - ISHARES UK GILTS UCITS ETF GBP*	GBP	189 001	35 000	105 000	119 001	2 010 619	2,05
Total Grossbritannien						2 010 619	2,05
Vereinigte Staaten							
ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR TREASURY BOND FUND*	USD		68 000	2 000	66 000	6 801 899	6,94
SPDR S&P 500 ETF TRUST-S1*	USD	35 025	5 500	1 500	39 025	9 486 593	9,68
Total Vereinigte Staaten						16 288 492	16,62
Total Investmentzertifikate, open end						68 998 965	70,38

Anleihen, fester Zins

CHF							
SWITZERLAND 1.25000% 14-28.05.26*	CHF		2 950 000		2 950 000	3 299 575	3,37
SWITZERLAND 3.25000% 07-27.06.27*	CHF		2 950 000		2 950 000	3 892 525	3,97
SWITZERLAND 4.00000% 98-08.04.28*	CHF		2 450 000		2 450 000	3 474 100	3,54
SWITZERLAND-REG-S 0.50000% 15-27.05.30*	CHF		3 200 000		3 200 000	3 347 200	3,41
Total CHF						14 013 400	14,29
Total Anleihen, fester Zins						14 013 400	14,29
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						83 012 365	84,68

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Schweiz							
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-B2**	CHF	34 000	33 000	67 000			
SWISS INDEX PLATFORM - SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E**	CHF	57 505	10 000		67 505	7 310 802	7,46
SYZ AM (CH) TRACK - SWISS GOVERNMENT BONDS-I1**	CHF	20 000	15 500		35 500	3 768 679	3,84
Total Schweiz						11 079 481	11,30
Total Investmentzertifikate, open end						11 079 481	11,30
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						11 079 481	11,30
Total Wertschriften						94 091 846	95,98
(davon ausgeliehen)						2 038 848	2,08)
Bankguthaben auf Sicht						3 781 884	3,86
Derivative Finanzinstrumente						-163 783	-0,17
Sonstige Vermögenswerte						323 165	0,33
Gesamtfondsvermögen						98 033 112	100,00
Andere Verbindlichkeiten						-241 035	
Nettofondsvermögen						97 792 077	

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.09.2017	in % des Gesamt- fondsvermögens ³	Verkehrswert Vorjahr	in %
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	83 012 365	84,68	71 054 295	80,58
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	10 915 698	11,13	12 227 580	13,87
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	—	—	—	—
Total	93 928 063	95,81	83 281 875	94,45

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	100 000	CHF	113 050	15.11.2017	-1 272	0.00
EUR	4 750 000	CHF	5 420 938	30.11.2017	-8 297	-0.01
USD	6 600 000	CHF	6 306 960	30.11.2017	-52 306	-0.05
GBP	1 500 000	CHF	1 853 550	30.11.2017	-89 287	-0.09
USD	320 000	CHF	301 696	30.11.2017	-6 632	-0.01
USD	300 000	CHF	283 365	30.11.2017	-5 693	-0.01
CHF	115 920	USD	120 000	30.11.2017	-296	0.00
					-163 783	-0.17

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	100 000	CHF	113 050	15.11.2017
EUR	4 750 000	CHF	5 420 938	30.11.2017
USD	6 600 000	CHF	6 306 960	30.11.2017
GBP	1 500 000	CHF	1 853 550	30.11.2017
USD	320 000	CHF	301 696	30.11.2017
USD	300 000	CHF	283 365	30.11.2017
CHF	115 920	USD	120 000	30.11.2017

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission
– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission: 1% p.a.;
– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag: 1,5% p.a.;
berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofondsvermögen.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 2% p.a. betragen.

Ausgabe- und Rücknahmekommissionen

Effektive Kommission:
Ausgabe: 2%; Rücknahme: 0%

Maximale Kommission gemäss Fondsvertrag:
Ausgabe: 5%; Rücknahme: 0%

Soft Commission Arrangements

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich «soft commission arrangements» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der SFAMA in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

Zusammengesetzte TER
für die letzten 12 Monate: 1,17%*

Auflegungsdatum

1.10.2010

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 1.143897 USD 1 = CHF 0.967600
GBP 1 = CHF 1.298181

* Der Zielfonds SWISS INDEX PLATFORM – SWISS GOVERNMENT BOND INDEX-E veröffentlicht keine TER gemäss Branchenstandard. Der Anteil der zusammengesetzten TER wird gemäss «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio von kollektiven Kapitalanlagen» ermittelt.

Vertriebs- und Zahlstellen

Vertriebsstellen

Fortuna Investment AG 8134 Adliswil 1	Soodmattenstrasse 10	058/472 53 05
GENERALI Versicherungen 8134 Adliswil 1	Soodmattenstrasse 10	058/472 44 44

Agenturen

5001 Aarau	Rain 35	058/473 90 30
8134 Adliswil	Soodmattenstrasse 4	058/472 75 00
6340 Baar	Zugerstrasse 76a	058/473 09 99
4051 Basel	Schützengraben 21	058/473 37 00
6501 Bellinzona	Via Lugano 22	058/471 60 60
3001 Bern	Monbijoustrasse 29	058/473 32 22
2502 Bienne	Rue de la Gare 14	058/473 74 52
7007 Chur	Ringstrasse 18	058/473 84 71
2800 Delémont	Rue des Moulins 9	058/471 49 49
1701 Fribourg	Route d'Agy 14-16	058/471 28 18
1215 Genève 15	I.C.C. Rte de Pré-Bois 20	058/471 07 00
1211 Genève 26	Route des Acacias 47	058/471 37 37
1211 Genève 3	Rue du Rhône 67	058/471 94 94
1005 Lausanne	Place de la Riponne 3	058/471 34 84
1052 Le Mont-sur-Lausanne	Rue du Village 10	058/471 25 25
6904 Lugano	Via Trevano 78	058/471 17 17
6002 Luzern	Nidfelfdstrasse 12	058/473 18 18
1870 Monthey 1	Rue du Coppet 3	058/471 36 00
1820 Montreux 2	Avenue du Casino 50	058/471 47 00
2001 Neuchâtel	Faubourg de 'Hôpital 1	058/471 96 66
1260 Nyon 1	Avenue Perdttemps 23	058/471 44 44
4600 Olten	Ziegelfeldstrasse 36	058/473 38 38
8640 Rapperswil	Alte Jonastrasse 24	058/473 89 50
9494 Schaan	Zollstrasse 13	00423 239 72 72
1951 Sion	Avenue de la Gare 32	058/471 78 10
9001 St. Gallen	Bahnhofstrasse 11	058/473 36 36
3601 Thun	Burgstrasse 20	058/473 06 15
8400 Winterthur	Bahnhofplatz 8	058/473 16 66
1400 Yverdon-les-Bains	Rue du Milieu 7	058/471 09 61
8008 Zürich	Mühlebachstrasse 7	058/473 91 20

Zahlstellen

EFG Bank AG, 6900 Lugano mit sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz	Via Magatti 2	091/809 31 11
--	---------------	---------------